

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em outubro de 2024

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			897.702.588,68	33,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	96.099.762,25	3,55%	782	2,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	30.012.573,15	1,11%	95.485	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	939.000,00	0,03%	1.030	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDE...	D+0	Não há	293.118.234,54	10,83%	1.235	1,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	283.085.492,11	10,46%	516	4,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	D+0	Não há	203.202.502,31	7,51%	442	2,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FICAÇÕES	D+3	Não há	60.127.270,69	2,22%	21.388	4,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+4	Não há	39.155.581,47	1,45%	25.525	4,70%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	D+3	Não há	37.162.066,66	1,37%	15.747	3,47%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FICAÇÕES	D+3	Não há	28.672.697,81	1,06%	47	11,32%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	D+25	Não há	34.947.814,40	1,29%	822	6,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	D+15	Não há	45.498.921,13	1,68%	194	5,68%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FICAÇÕES	D+24	Não há	146.149.762,72	5,40%	13.905	9,97%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	48.283.965,89	1,78%	30	15,00%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕ...	D+24	Não há	8.745.108,86	0,32%	14	7,37%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	D+33	Não há	1.054.777,81	0,04%	2.560	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	D+3	Não há	1.812.140,27	0,07%	101	1,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	47.288.342,94	1,75%	113	2,74%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	37.150.982,34	1,37%	39	11,74%	Artigo 9º, Inciso II



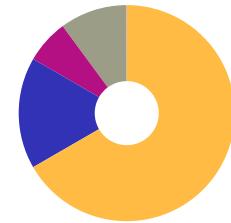
**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	7.209.259,87	0,27%	52	7,02%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO...	D+8	Não há	41.145.227,62	1,52%	4.697	6,08%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	36.636.153,57	1,35%	442	1,29%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.629.965,83	0,28%	316	0,97%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICA NA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	134.078.834,74	4,95%	8.225	6,49%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	137.174.793,83	5,07%	595	9,81%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.250.000,00	0,08%		1,68%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.706.333.821,49</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>567.152,98</b>				Artigo 6º
		<b>PL Total</b>	<b>2.706.900.974,47</b>				



## Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	897.702.588,68	33,17%	10,00%	60,00%	100,00%	1.808.631.232,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	126.112.335,40	4,66%	0,00%	3,00%	90,00%	2.309.588.103,94
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.435.700.439,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	780.345.228,96	28,83%	2,00%	3,00%	65,00%	978.771.755,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.759.116.983,97
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.316.691,07
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.804.160.153,04</b>	<b>66,66%</b>	<b>12,00%</b>	<b>66,00%</b>	<b>415,00%</b>	



- █ RENDA FIXA 1.804.160.153,04
- █ RENDA VARIÁVEL 451.610.107,71
- █ EXTERIOR 177.059.932,17
- █ ESTRUTURADOS 271.253.628,57
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 2.250.000,00

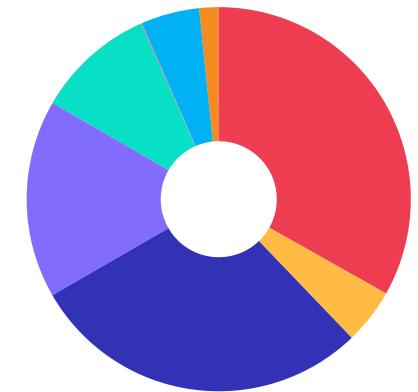
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!





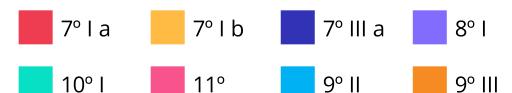
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	451.610.107,71	16,69%	0,00%	18,20%	35,00%	495.606.729,81
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	947.216.837,52
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	271.253.628,57	10,02%	0,00%	9,50%	10,00%	-620.246,42
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.316.691,07
Artigo 11º	5,00%	2.250.000,00	0,08%	0,00%	0,30%	5,00%	133.066.691,07
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	725.113.736,28	26,79%	0,00%	28,00%	90,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	132.793.812,77	4,91%	0,00%	4,30%	10,00%	137.839.569,38
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	44.266.119,40	1,64%	0,00%	1,70%	10,00%	226.367.262,75
Total Exterior	10,00%	177.059.932,17	6,54%	0,00%	6,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	270.633.382,15





**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	897.702.588,68	33,17	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	126.112.335,40	4,66	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	780.345.228,96	28,83	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	451.610.107,71	16,69	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	132.793.812,77	4,91	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	44.266.119,40	1,64	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	271.253.628,57	10,02	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.250.000,00	0,08	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	897.702.588,68	33,17	-
CAIXA DTVM	632.596.978,20	23,37	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	514.941.478,64	19,03	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	493.736.318,73	18,24	-
ITAÚ DTVM	57.029.074,75	2,11	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	41.145.227,62	1,52	-
XP ASSET MANAGEMENT	30.012.573,15	1,11	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	28.672.697,81	1,06	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	7.629.965,83	0,28	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE INVESTIMENTOS	2.866.918,08	0,11	-

**Artigo 20º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,81%	5,86%	1,81%	3,85%	9,37%	19,24%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	5,53%	1,76%	3,75%	8,86%	18,70%	0,94%	1,82%

CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,95%	9,03%	2,71%	5,32%	10,99%	25,77%	0,07%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,92%	9,07%	2,66%	5,34%	11,18%	26,34%	0,04%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,93%	9,12%	2,69%	5,38%	11,11%	25,94%	0,02%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	8,10%	2,40%	4,75%	9,90%	23,39%	0,03%	0,04%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,93%	9,37%	2,70%	5,43%	11,50%	26,96%	0,02%	0,07%



## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,02%	50,50%	6,38%	29,14%	64,77%	95,02%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	5,92%	48,88%	6,17%	28,45%	62,54%	89,30%	6,60%	15,49%

Ibovespa (Benchmark)	-1,60%	-3,33%	1,61%	3,01%	14,64%	11,79%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIAÇÕES	-1,51%	-7,97%	-1,25%	-0,23%	7,31%	-4,30%	4,62%	12,94%
ITAÚ DUNAMIS FIAÇÕES	-2,34%	8,56%	4,11%	8,12%	31,93%	12,68%	5,98%	12,73%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIAÇÕES	-1,02%	-8,59%	0,36%	1,75%	7,23%	1,69%	4,43%	12,04%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	-1,63%	-3,42%	1,64%	3,03%	14,64%	11,92%	4,66%	12,12%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIAÇÕES	-1,28%	-5,41%	1,52%	0,38%	12,49%	1,63%	5,24%	14,93%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	-1,35%	-6,83%	0,45%	0,86%	9,44%	3,00%	4,53%	12,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIAÇÕES	-1,40%	-5,76%	0,62%	1,94%	10,96%	-2,67%	4,74%	13,09%
BB IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	-1,18%	-7,43%	0,90%	1,60%	10,72%	4,05%	4,43%	13,17%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIAÇÕES	1,08%	0,68%	7,35%	5,48%	22,19%	20,71%	5,95%	14,94%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIAÇÕES	-1,39%	-3,76%	1,85%	1,58%	14,17%	4,47%	4,85%	13,51%

IFIX (Benchmark)	-3,06%	-3,22%	-4,75%	-5,23%	1,56%	7,13%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-7,41%	-6,37%	-4,80%	-5,26%	-6,16%	8,23%	31,35%	45,48%

MSCI ACWI (Benchmark)	3,63%	36,63%	4,32%	22,90%	49,35%	56,01%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,34%	23,65%	4,51%	15,67%	42,23%	66,12%	5,28%	12,08%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	<b>-0,99%</b>	19,62%	3,32%	13,30%	36,04%	47,35%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	<b>-0,15%</b>	22,56%	3,92%	15,11%	39,90%	57,54%	5,00%	12,16%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	<b>-0,33%</b>	23,74%	4,54%	15,77%	42,28%	66,23%	5,27%	12,07%

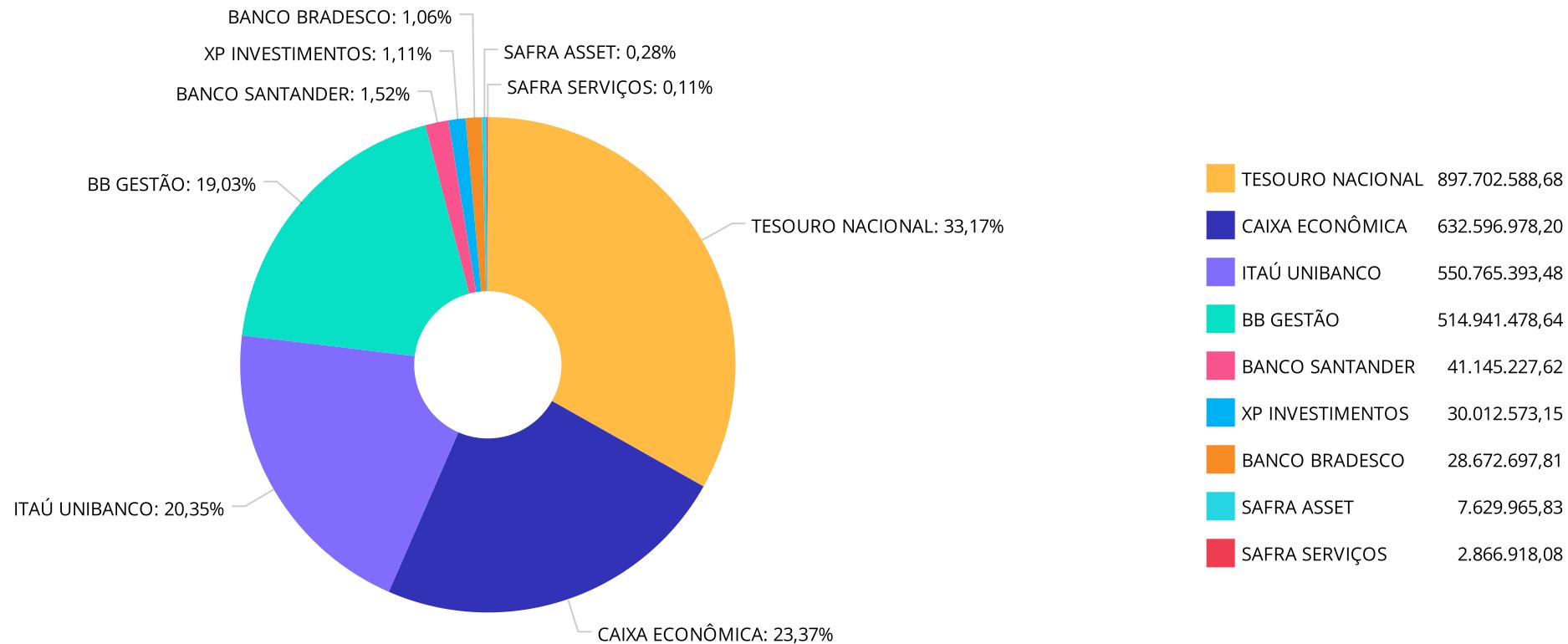


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	6,02%	50,50%	6,38%	29,14%	64,77%	95,02%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4,65%	36,28%	5,76%	24,42%	48,41%	62,50%	6,97%	13,818%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	5,92%	48,88%	6,17%	28,45%	62,54%	89,30%	6,60%	15,494%

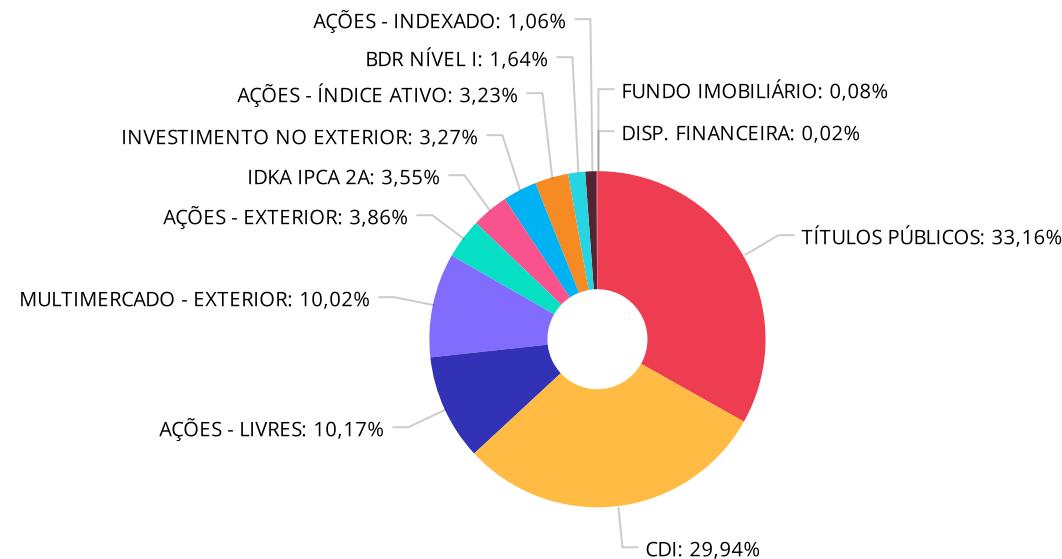
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	3,89%	37,35%	4,20%	23,27%	50,50%	57,34%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1,64%	26,91%	1,57%	15,09%	41,24%	36,69%	6,55%	15,197%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	3,93%	37,95%	4,94%	21,01%	51,85%	70,57%	5,54%	14,620%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,42%	36,05%	4,90%	21,88%	50,77%	55,99%	5,51%	12,086%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FICAÇÕES	1,32%	31,73%	4,55%	20,02%	43,34%	55,50%	6,20%	13,597%

## Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2024)





Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2024)



■ TÍTULOS PÚBLICOS	897.702.588,68	■ CDI	810.357.802,11	■ AÇÕES - LIVRES	275.370.591,85	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	271.253.628,57
■ AÇÕES - EXTERIOR	104.487.512,90	■ IDKA IPCA 2A	96.099.762,25	■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	88.433.570,56	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	87.439.547,36
■ BDR NÍVEL I	44.266.119,40	■ AÇÕES - INDEXADO	28.672.697,81	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.250.000,00	■ DISP. FINANCEIRA	567.152,98



## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.420,930542	39.843.549,55	45.690.317,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4.089,215327	4.410,752117	40.000.704,33	43.145.977,20	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4.062,955171	4.384,901873	30.000.860,98	32.378.115,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4.004,964372	4.431,573993	39.997.579,18	44.258.129,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.558,943375	39.997.709,63	45.803.704,08	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.545,601033	58.915.192,29	68.593.119,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4.047,135758	4.505,878231	1.197.952,18	1.333.739,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.466,620456	1.984.874,49	2.224.376,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.438,123474	15.078.262,63	17.264.300,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.494,748024	39.862.509,79	45.747.545,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.472,852677	39.994.357,14	45.734.918,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.586,484228	58.961.325,11	68.866.060,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.555,753382	9.639.666,59	10.933.808,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4.131,678715	4.560,855632	19.997.324,98	22.074.541,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4.113,158402	4.535,435647	9.501.395,91	10.476.856,34	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4.039,820802	4.510,224271	900.880,04	1.005.780,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.510,224271	2.086.995,07	2.345.316,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.466,937717	19.725.991,27	22.066.672,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.450,057699	39.229.327,99	43.566.064,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	4.157,265012	37.851.990,52	41.572.650,11	Curva



Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2024)

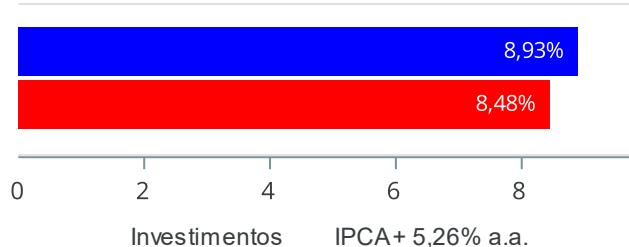
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3.816,987204	4.157,265012	39.998.208,91	43.563.980,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.412,733911	19.846.240,66	22.284.306,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3.851,268116	4.193,723938	39.999.270,65	43.556.016,82	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	4.128,833221	38.836.282,35	42.638.460,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3.792,196447	4.128,833221	40.003.880,32	43.555.061,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.393,420111	19.568.465,57	21.681.528,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.302,118511	19.536.375,31	21.613.843,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.284,243251	40.000.529,76	43.754.976,32	Curva



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	2.567.523.344,80	45.095.927,70	48.822.037,76	2.569.922.536,57	6.125.301,83	6.125.301,83	0,23%	0,23%	0,87%	0,87%	26,94%	3,19%
Fevereiro	2.569.922.536,57	58.312.581,69	62.621.601,41	2.610.448.028,88	44.834.512,03	50.959.813,86	1,71%	1,94%	1,22%	2,10%	92,52%	3,53%
Março	2.610.448.028,88	33.594.187,36	44.184.187,36	2.629.918.510,18	30.060.481,30	81.020.295,16	1,14%	3,10%	0,57%	2,68%	115,72%	2,91%
Abril	2.629.918.510,18	40.962.954,53	48.037.406,87	2.608.903.681,39	<b>-13.940.376,45</b>	67.079.918,71	-0,52%	2,57%	0,83%	3,53%	72,58%	3,59%
Maio	2.608.903.681,39	36.565.347,44	51.724.247,54	2.617.357.295,49	23.612.514,20	90.692.432,91	0,89%	3,48%	0,89%	4,46%	78,11%	2,76%
Junho	2.617.357.295,49	155.426.054,88	169.999.186,01	2.646.377.469,80	43.593.305,44	134.285.738,35	1,57%	5,11%	0,62%	5,10%	100,11%	2,52%
Julho	2.646.377.469,80	108.635.700,00	119.435.955,52	2.667.369.140,94	31.791.926,66	166.077.665,01	1,15%	6,32%	0,85%	6,00%	105,41%	3,15%
Agosto	2.667.369.140,94	325.294.955,59	339.427.829,40	2.698.566.075,99	45.329.808,86	211.407.473,87	1,51%	7,93%	0,43%	6,45%	122,96%	3,83%
Setembro	2.698.566.075,99	112.071.700,00	126.418.656,05	2.694.382.808,93	10.163.688,99	221.571.162,86	0,36%	8,32%	0,87%	7,38%	112,81%	3,15%
Outubro	2.694.382.808,93	491.889.679,78	506.349.292,88	2.697.757.838,87	17.834.643,04	239.405.805,90	0,56%	8,93%	1,03%	8,48%	105,23%	2,79%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

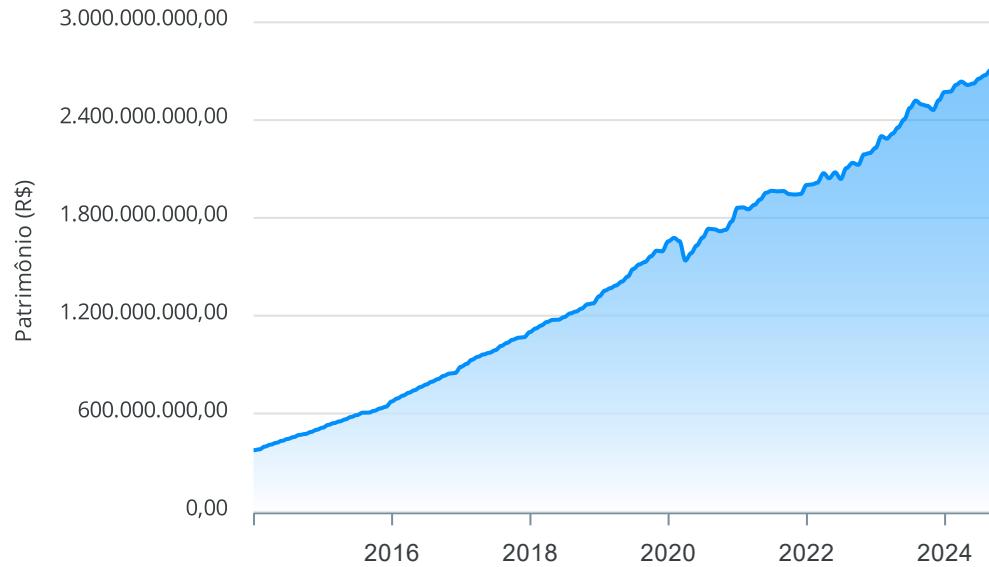




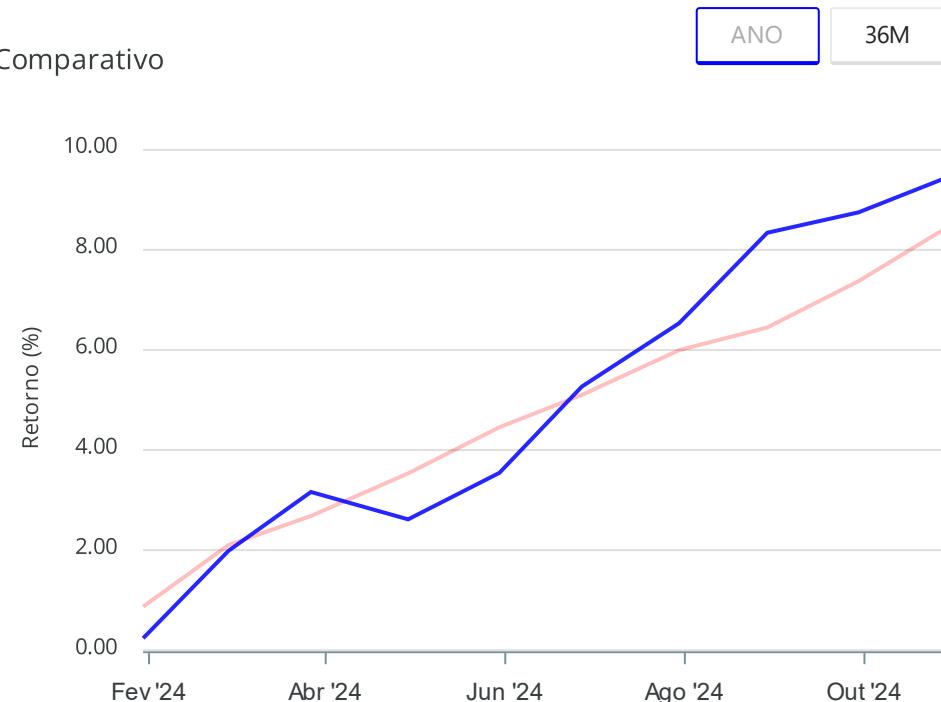
CRÉDITO  
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos

- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMML
- IDIV

Meta de Rentabilidade



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	888.377.001,85	0,00	0,00	897.702.588,68	9.325.586,83	1,05%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	201.327.645,38	0,00	0,00	203.202.502,31	1.874.856,93	0,93%	0,93%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	95.358.338,20	17.700,00	0,00	96.099.762,25	723.724,05	0,76%	0,76%	0,94%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	110.919.910,49	200.165.210,90	30.000.000,00	283.085.492,11	2.000.370,72	0,64%	0,92%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENC...	534.457.908,20	180.231.000,00	425.344.343,13	293.118.234,54	3.773.669,47	0,53%	0,93%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	164.972,16	0,00	165.210,90	0,00	238,74	0,14%	0,84%	0,00%
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00	30.000.000,00	0,00	30.012.573,15	12.573,15	0,04%	0,95%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	13.334.000,00	12.399.969,97	939.000,00	4.969,97	0,04%	0,85%	0,03%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.830.605.776,28</b>	<b>423.747.910,90</b>	<b>467.909.524,00</b>	<b>1.804.160.153,04</b>	<b>17.715.989,86</b>	<b>0,97%</b>		<b>0,12%</b>



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	45.013.591,97	0,00	0,00	45.498.921,13	485.329,16	1,08%	1,08%	5,95%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	38.921.006,02	0,00	39.264.768,88	0,00	343.762,86	0,88%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FICAÇÕES	60.217.019,63	0,00	0,00	60.127.270,69	-89.748,94	-0,15%	-0,15%	5,00%
BB IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	0,00	39.264.768,88	0,00	39.155.581,47	-109.187,41	-0,28%	-1,18%	4,43%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	137.630.183,45	0,00	0,00	137.174.793,83	-455.389,62	-0,33%	-0,33%	5,27%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	134.535.183,98	0,00	0,00	134.078.834,74	-456.349,24	-0,34%	-0,34%	5,28%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	37.543.246,92	0,00	0,00	37.162.066,66	-381.180,26	-1,02%	-1,02%	4,43%
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	1.068.488,18	0,00	0,00	1.054.777,81	-13.710,37	-1,28%	-1,28%	5,24%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	48.945.733,87	0,00	0,00	48.283.965,89	-661.767,98	-1,35%	-1,35%	4,53%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	1.837.674,47	0,00	0,00	1.812.140,27	-25.534,20	-1,39%	-1,39%	4,85%
ITAU INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕES	8.868.935,68	0,00	0,00	8.745.108,86	-123.826,82	-1,40%	-1,40%	4,74%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	35.484.203,68	0,00	0,00	34.947.814,40	-536.389,28	-1,51%	-1,51%	4,62%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FICAÇÕES	29.146.789,44	0,00	0,00	28.672.697,81	-474.091,63	-1,63%	-1,63%	4,66%
ITAU DUNAMIS FICAÇÕES	119.894.880,64	30.000.000,00	0,00	146.149.762,72	-3.745.117,92	-2,50%	-2,34%	5,98%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.430.000,00	0,00	17.700,00	2.250.000,00	-162.300,00	-6,68%	-6,68%	31,35%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>701.536.937,93</b>	<b>69.264.768,88</b>	<b>39.282.468,88</b>	<b>725.113.736,28</b>	<b>-6.405.501,65</b>	<b>-0,88%</b>		<b>5,31%</b>



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Outubro / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	34.589.058,68	0,00	0,00	36.636.153,57	2.047.094,89	5,92%	5,92%	6,60%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	7.290.685,86	0,00	0,00	7.629.965,83	339.279,97	4,65%	4,65%	6,97%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	39.405.345,98	0,00	0,00	41.145.227,62	1.739.881,64	4,42%	4,42%	5,51%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	45.502.331,23	0,00	0,00	47.288.342,94	1.786.011,71	3,93%	3,93%	5,54%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	36.552.545,52	0,00	0,00	37.150.982,34	598.436,82	1,64%	1,64%	6,55%
ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	7.114.986,32	0,00	0,00	7.209.259,87	94.273,55	1,32%	1,33%	6,20%
<b>Total Exterior</b>	<b>170.454.953,59</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>177.059.932,17</b>	<b>6.604.978,58</b>	<b>3,87%</b>		<b>6,05%</b>

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.



